

DAFTAR ISI

ABSTRAK	iii
ABSTRACT	iv
LEMBAR PENGESAHAN	v
PERNYATAAN ORISINALITAS.....	vi
KATA PENGANTAR.....	vii
DAFTAR ISI.....	vii
DAFTAR GAMBAR.....	ix
DAFTAR TABEL	x
DAFTAR LAMPIRAN	xi
BAB I PENDAHULUAN.....	1
A. Latar Belakang Masalah.....	1
B. Rumusan Masalah	7
C. Tujuan Penelitian	8
D. Manfaat Penelitian	8
BAB II KAJIAN TEORITIK.....	10
A. Deskripsi Konsptual	10
1. Teori Perilaku Keuangan.....	10
2. <i>Bid-Ask Spread</i>	11
3. Volume Perdagangan	15
4. <i>Return</i>	17
5. <i>Varian Return</i>	18
B. Penelitian Relevan.....	21
C. Kerangka Pemikiran.....	32
D. Perumusan Hipotesis Penelitian.....	34
BAB III METODOLOGI PENELITIAN	35

A. Objek dan Ruang Lingkup Penelitian	35
B. Metode Penelitian.....	35
C. Teknik Penentuan Populasi dan Sampel	36
D. Teknik Pengumpulan Data dan	37
E. Operasionalisasi Variabel Penelitian.....	38
1. Variabel Terikat (<i>Dependent Variable</i>).....	38
2. Variabel Bebas (<i>Independent Variable</i>)	39
F. Metode Analisis Data.....	42
1. Analisis Statistik Deskriptif.....	43
2. Analisis Regresi Data Panel	43
3. Uji Asumsi Klasik	46
4. Uji Hipotesis.....	47
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN.....	49
A. Statistik Deskriptif	49
B. Uji Asumsi Klasik.....	53
C. Penentuan Model Regresi Data Panel	54
D. Hasil Regresi Data Panel.....	57
E. Hasil Uji Hipotesis	58
F. Koefisien Determinasi.....	62
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN	64
A. Kesimpulan	64
B. Implikasi.....	65
C. Saran.....	66
DAFTAR PUSTAKA	67